

2011

PREVIFIN

Corso di Finanza quantitativa per la previdenza complementare
II edizione



MEFOP

Sviluppo Mercato Fondi Pensione



MASTER PREVCOMP DI II LIVELLO

**CORSO PROFESSIONALIZZANTE
MEFOP - UNITUS**

CORSI DI ALTA FORMAZIONE

SEMINARI DI SPECIALIZZAZIONE

MASTER BREVE

PREVIFIN

PREVILAB

CORSI FAD

WORKSHOP

PREVIFIN

Corso di Finanza quantitativa per la previdenza complementare

II edizione

Previfin è un corso specialistico che intende approfondire i principali aspetti attinenti la gestione finanziaria degli investitori previdenziali (fondi pensione e casse di previdenza).

La seconda edizione del corso introduce importanti elementi di novità, a partire dal programma. Sono stati infatti inseriti due nuovi moduli dedicati ai modelli per la definizione dell'asset allocation strategica e al controllo della gestione finanziaria. I contenuti degli altri moduli sono stati notevolmente rivisti. Ampio spazio è riservato anche agli investimenti alternativi.

Per consentire ai partecipanti di applicare concretamente i concetti appresi, le lezioni teoriche saranno affiancate da esercitazioni pratiche. I partecipanti avranno quindi modo di familiarizzare con le metodologie e i modelli illustrati nel corso attraverso un approccio operativo e orientato a indagare le migliori prassi operative per gli investitori previdenziali.

Sono inoltre previste testimonianze esterne; alcuni operatori porteranno la loro esperienza professionale per approfondire con taglio tecnico alcune delle tematiche affrontate nel corso delle lezioni.



PREVIFIN

Corso di Finanza quantitativa per la previdenza complementare II edizione

Destinatari

Il corso si rivolge principalmente ai consiglieri di amministrazione, ai direttori e ai responsabili dell'area finanza dei fondi pensione. Per privilegiare l'interazione fra i partecipanti e il docente, si è posto un limite al numero di iscritti frontali alle singole sessioni formative. Il limite prefissato per la presenza in aula è di 30 partecipanti. Al fine di soddisfare le eventuali richieste di coloro che non potranno partecipare direttamente in aula, Mefop ha predisposto un sistema di videoconferenza differita, attraverso il quale l'utente potrà seguire le lezioni a distanza con la massima flessibilità, nelle modalità e nei tempi che meglio soddisfano le proprie esigenze.

Obiettivi

Partendo da un insieme di conoscenze già consolidato in ambito finanziario, il corso ha l'obiettivo di affrontare tutte le principali questioni che coinvolgono tali aspetti nella gestione degli investitori previdenziali. Per assicurare un livello di didattica adeguato all'obiettivo prefissato, Mefop prevede di somministrare un questionario di autovalutazione (disponibile al seguente link <http://www.mefop.it/questionario-finanza.php>). Potranno comunque accedere al corso coloro che hanno partecipato ai corsi/master promossi da Mefop e similari o hanno conseguito una laurea in economia o statistica.

Sede

L'intero corso si svolgerà a Roma, presso la sede nazionale Filca in Via del Viminale n. 43.

Durata

Il corso, la cui supervisione scientifica è stata affidata al Prof. Riccardo Cesari (Università di Bologna), è strutturato in 11 incontri di 4 ore ciascuno.

Gli incontri si terranno con cadenza quindicinale dalle 14,30 alle 18,30, nei seguenti giorni (il calendario delle lezioni è ancora provvisorio, potrà quindi subire delle modifiche):

27 ottobre 2011
10 novembre 2011
24 novembre 2011
15 dicembre 2011
12 gennaio 2012
26 gennaio 2012
9 febbraio 2012
23 febbraio 2012
8 marzo 2012
22 marzo 2012
5 aprile 2012



MEFOP

Sviluppo Mercato Fondi Pensione

Moduli

Il corso è strutturato in 4 moduli secondo il seguente programma:

1 Analisi economico-giuridica degli strumenti finanziari (3 incontri)

- Il quadro giuridico-normativo
- Immobili*
- Private equity*
- Hedge funds*
- Prezzi e rendimenti
- Esercitazione pratica

**Sono previste testimonianze da parte di operatori specializzati*

2 Misure di rischio e risk management (3 incontri)

- Fonti di rischio e misurazione
- Volatilità
- Duration e convexity
- Greche
- Var e quantili
- CVar
- Esercitazione pratica

3 Modelli di asset allocation strategica (3 incontri)

- Rischio e rendimento
- La frontiera efficiente: costruzione e simulazione
- Stime della redditività attesa
- Stima della volatilità e delle correlazioni
- Modelli di asset allocation strategica alternativi (Idi, life cycle,...)
- Il risk overlay: testimonianza esterna
- Pianificazione previdenziale: modelli di valutazione del rischio nelle simulazioni
- Esercitazione pratica

4 Controllo della gestione finanziaria (2 incontri)

- Asset allocation strategica e asset allocation tattica
- Le scommesse di timing e picking
- Misure di performance corrette per il rischio
- Stime di alfa, beta e gamma
- Performance e persistenza
- Il rating delle gestioni

Costi

Il costo del Corso di Finanza quantitativa per la previdenza complementare per coloro che intendono frequentare il corso in presenza è riportato nella tabella seguente:

Tipologia di partecipante

SOCIO MEFOP

Costo per partecipante - 2.500 € + Iva + 1 Ticket

ABBONATO

Costo per partecipante - 3.000 € + Iva

NON SOCIO

Costo per partecipante - 3.500 € + Iva

Agevolazioni

Al Socio Mefop che non utilizza il ticket verrà applicato il prezzo riservato agli abbonati. Per i partecipanti alla I edizione sono previste riduzioni di costo.

Per coloro che intendono frequentare il corso secondo la modalità di videoconferenza differita è prevista una riduzione dei costi sopra riportati pari al 30%.

PREVIFIN – Corso di Finanza quantitativa per la previdenza complementare

Modulo di registrazione e dati per la fatturazione

Da restituirsi via fax al n. 06.48073548

Nome: _____
Cognome: _____
Fondo/società: _____
Indirizzo: _____
Città: _____
Cap: _____
P.I. / C.F.: _____
Tel: _____
Fax: _____
e-mail: _____

Titolo di studio

- Laurea in materie economiche o statistiche Corso/Master Mefop:
 Altri corsi in materia economica, finanziaria o statistica: _____

ATTENZIONE: è consigliabile compilare il questionario di autovalutazione al link
<http://www.mefop.it/questionario-finanza.php>

Barrare Tipologia partecipante

- Fondo pensione socio: _____ Utilizzo il ticket (indicare SÌ o NO): _____
 Abbonato: _____
 Altro: _____ Frequenza I edizione (indicare SÌ o NO): _____

Modalità frequenza

Presenza in aula [] Videoconferenza differita []

| Tipologia di partecipante | Costo per partecipante |
|---------------------------|------------------------|
| Socio Mefop | 2.500 € +Iva+1 Ticket |
| Abbonato | 3.000 € + Iva |
| Non socio | 3.500 € + Iva |

Per la partecipazione in videoconferenza differita è prevista una riduzione dei costi pari al 30%.

Al Socio Mefop che non utilizza il ticket verrà applicato il prezzo riservato agli abbonati. Per i partecipanti alla I edizione sono previste riduzioni di costo.

L'importo dovuto dovrà essere bonificato sul c/c N°: 000004934473 intestato a MEFOP S.p.A. c/o BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA S.P.A. via del Corso, 232 00186 Roma - ABI 01030 - CAB 03200 - CIN D; BANK ACCOUNT (IBAN): IT15D0103003200000004934473 entro 30 giorni dal ricevimento della fattura.

Per ulteriori informazioni in merito al pagamento Vi preghiamo di contattare
Marianna Pascuzzo Tel. 06.48073530 - Fax 06.48073548 e-mail: pascuzzo@mefop.it
Arianna Taroni Tel. 06.48073535 e-mail: taroni@mefop.it

Per motivi organizzativi Vi preghiamo di comunicarci la vostra partecipazione, inviandoci il modulo di registrazione via fax entro e non oltre il 15 settembre 2011

Do il consenso al trattamento dei dati personali []

Info privacy su www.mefop.it

Firma: _____



MEFOP

Sviluppo Mercato Fondi Pensione

MEFOP

Via Milano, 58 - 00184 Roma

TEL: (++39). 06.48073530

FAX: (++39). 06.48073548

EMAIL: mefop@mefop.it

WEB: www.mefop.it